

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

MTS Fonds

31. März 2024

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

Vermögensübersicht per 31.03.2024	4
Vermögensaufstellung per 31.03.2024	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Allgemeine Angaben	11

Einleitende Worte

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie über die Entwicklung des OGAW-Fonds

MTS Fonds

in der Zeit vom 04.10.2022 bis 31.03.2024.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von + 5,06% in der Klasse I sowie von + 5,67% in der Klasse R

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende März darstellte. Abseits dessen stehen wir Ihnen aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre

HANSAINVEST-Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz, Ludger Wibbeke

Vermögensübersicht per 31.03.2024

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	856.339,59	101,49
1. Investmentanteile	595.962,73	70,63
2. Bankguthaben	260.136,95	30,83
3. Sonstige Vermögensgegenstände	239,91	0,03
II. Verbindlichkeiten	-12.567,71	-1,49
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-12.567,71	-1,49
III. Fondsvermögen	EUR 843.771,88	100,00

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung per 31.03.2024

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
Investmentanteile							EUR		595.962,73	70,63
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR		595.962,73	70,63
LU0411078552	db x-tr.S&P 500 2x LEV.DLY.ETF	ANT		345	345	0	EUR	176,8200	61.002,90	7,23
LU0659579063	DB x-trackers ATX ETF (DR) Inhaber-Anteile 1C EUR o.N.	ANT		413	413	0	EUR	66,3900	27.419,07	3,25
LU0411075376	db x-trackers LEVDAX DAILY ETF 1C	ANT		394	394	0	EUR	181,4800	71.503,12	8,47
IE00BMW42074	iS.VI p.-iSh.MSCI Eu.Co.St.Se. Reg. Shs EUR Acc. oN	ANT		4.390	4.390	0	EUR	5,4450	23.903,55	2,83
DE000A0H08S0	iSh.ST.Eu.600 Trav.&L.U.ETF DE	ANT		1.080	7.210	6.130	EUR	23,6600	25.552,80	3,03
DE0005933931	iShares Core DAX UCITS ETF DE Inhaber-Anteile EUR Acc.	ANT		426	426	0	EUR	154,6200	65.868,12	7,81
DE000A0H08J9	iShares ST.Eu.600 In.G.&S.U.ETF DE	ANT		314	689	375	EUR	86,2000	27.066,80	3,21
IE00B5BMR087	iShares VII-Core S&P 500 U.ETF	ANT		89	284	283	EUR	507,5000	45.167,50	5,35
IE00BGR7L912	iShs DL Treas.Bd 0-1yr UC.ETF Registered Shares USD (Dist)oN	ANT		197	0	9.193	EUR	4,6408	914,24	0,11
IE00B53L4350	iShsVII-DJ Indl Average U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N.	ANT		94	314	227	EUR	433,2000	40.720,80	4,83
IE00B53SZB19	iShsVII-NASDAQ 100 UCITS ETF Registered Shares o.N.	ANT		49	149	150	EUR	960,3000	47.054,70	5,58
IE00BKWQ0L68	SPDR MSCI Eur.Materials UETF Registered Shares o.N.	ANT		84	344	260	EUR	307,2500	25.809,00	3,06
IE00BKWQ0F09	SPDR MSCI Europe Energy UETF Registered Shares o.N.	ANT		127	127	0	EUR	203,1500	25.800,05	3,06
IE00B6YX5C33	SPDR S&P 500 UCITS ETF Registered Shares USD o.N.	ANT		152	152	0	EUR	481,7900	73.232,08	8,68
LU0274211480	Xtrackers DAX 1C	ANT		200	0	530	EUR	174,7400	34.948,00	4,14
Summe Wertpapiervermögen							EUR		595.962,73	70,63
Bankguthaben							EUR		260.136,95	30,83
EUR - Guthaben bei:							EUR		260.136,95	30,83
Bank: Donner & Reuschel AG			EUR	67.262,31				67.262,31	7,97	
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	67.080,75				67.080,75	7,95	
Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	125.793,89				125.793,89	14,91	
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR		239,91	0,03
Ansprüche auf Ausschüttung			USD	259,61				239,91	0,03	
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR		-12.567,71	-1,49
Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾			EUR	-12.567,71				-12.567,71	-1,49	
Fondsvermögen							EUR		843.771,88	100,00
Anteilwert MTS Fonds I							EUR		107,39	
Anteilwert MTS Fonds R							EUR		107,38	
Umlaufende Anteile MTS Fonds I							STK		410,000	
Umlaufende Anteile MTS Fonds R							STK		7.448,000	

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

²⁾ noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.03.2024

US-Dollar	(USD)	1,082100	=	1 Euro (EUR)
-----------	-------	----------	---	--------------

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
LU0292106241	db x-tr.SHORTDAX DAILY ETF	ANT	7.100	15.590
LU0292105359	db x-tra.STOXX 600 FOOD & BEVERAGE ETF 1C	ANT	165	165
DE000ETFL011	Deka DAX UCITS ETF Inhaber-Anteile	ANT	594	594
DE000ETFL185	ETFlab Dt.Börse EUROGOV Ge.1-3	ANT	1.600	1.820
IE00BMW42298	iS.VI p.-iSh.MSCI Eu.Co.Di.Se. Reg. Shs EUR Acc. oN	ANT	18.700	18.700
DE0006289473	iSh. eb.r.Governm. Ger.1.5-2.5	ANT	1.590	2.360
DE000A0H0728	iSh.Divers.Commo.Swap U.ETF DE	ANT	1.500	1.500
DE000A0F5UK5	iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE	ANT	445	445
DE000A0D8Q23	iShares ATX UCITS ETF DE	ANT	736	736
DE000A0H08M3	iShares ST.Eu.600 Oil&Gas U.ETF DE	ANT	653	653
DE000A0H08N1	ISHARES STiSh.ST.Eu.600 Pe.&H.G.U.ETF DE	ANT	253	253
DE000A0H08F7	iShares STOXX.Eur.600 Co.&Mat.	ANT	425	425
DE000A0Q4R28	iShares STOXX Europe 600 Automobiles & Parts (DE)	ANT	436	436
DE000A0H08E0	iShares STOXX Europe 600 Chemicals (DE)	ANT	214	214
IE00B4L5Y983	iShsIII-Cor.MSCI Wld UCITS ETF Registered Shs Acc. USD o.N.	ANT	0	530
IE00BMFKG444	Xtr.IE)Xtr.NASDAQ 100 ETF Reg. Shs 1C USD Acc. oN	ANT	1.260	1.260
LU0290358497	Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF	ANT	865	865

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Fehlanzeige				

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 70,63

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,00

ZUSÄTZLICHE ANHANGANGABEN GEMÄSS DER VERORDNUNG (EU) 2015/2365 BETREFFEND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

SONSTIGE ANGABEN

Anteilwert MTS Fonds I	EUR	107,39
Anteilwert MTS Fonds R	EUR	107,38
Umlaufende Anteile MTS Fonds I	STK	410,000
Umlaufende Anteile MTS Fonds R	STK	7.448,000

ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

	MTS Fonds I	MTS Fonds R
ISIN	DE000A3DCA46	DE000A3DCA53
Währung	Euro	Euro
Fondsaufgabe	04.10.2022	04.10.2022
Ertragsverwendung	Thesaurierend	Thesaurierend
Verwaltungsvergütung	1,235% p.a.	1,735% p.a.
Ausgabeaufschlag	0,00%	4,00%
Mindestanlagevolumen	10.000	0

ANGABE ZU DEN VERFAHREN ZUR BEWERTUNG DER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

Der Anteilwert wird durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH ermittelt. Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum Handel zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Schlusskursen des vorhergehenden Börsentages gem. § 27 KARBV. Investmentanteile werden zu den letzten veröffentlichten Rücknahmepreisen angesetzt.

Vermögenswerte, die weder an einer Börse zugelassen noch in einen organisierten Markt einbezogen sind oder für die ein handelbarer Kurs nicht verfügbar ist, werden mit von anerkannten Kursversorgern zur Verfügung gestellten Kursen bewertet. Sollten die ermittelten Kurse nicht belastbar sein, wird auf den mit geeigneten Bewertungsmodellen ermittelten Verkehrswert abgestellt (§ 28 KARBV).

Die bezogenen Kurse werden täglich durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft.

Bankguthaben und Festgelder werden mit dem Nominalbetrag und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet. Die Bewertung der sonstigen Vermögensgegenstände erfolgt zu ihrem Markt- bzw. Nominalbetrag.

AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandserstattungen.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse MTS Fonds I sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse MTS Fonds R sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
LU0411078552	db x-tr.S&P 500 2x LEV.DLY.ETF ¹⁾	0,40
LU0292106241	db x-tr.SHORTDAX DAILY ETF ¹⁾	0,40
LU0292105359	db x-tra.STOXX 600 FOOD & BEVERAGE ETF 1C ¹⁾	0,15
LU0659579063	DB x-trackers ATX ETF (DR) Inhaber-Anteile 1C EUR o.N. ¹⁾	0,10
LU0411075376	db x-trackers LEVDAX DAILY ETF 1C ¹⁾	0,15
DE000ETFLO11	Deka DAX UCITS ETF Inhaber-Anteile ¹⁾	0,15
DE000ETF1185	ETFlab Dt.Börse EUROGOV Ge.1-3 ¹⁾	0,15
IE00BMW42298	iS.VI p.-iSh.MSCI Eu.Co.Di.Se. Reg. Shs EUR Acc. oN ¹⁾	0,18
IE00BMW42074	iS.VI p.-iSh.MSCI Eu.Co.St.Se. Reg. Shs EUR Acc. oN ¹⁾	0,18
DE0006289473	iSh. eb.r.Governm. Ger.1.5-2.5 ¹⁾	0,15
DE000A0H0728	iSh.Divers.Commo.Swap U.ETF DE ¹⁾	1,00
DE000A0F5UK5	iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0H0850	iSh.ST.Eu.600 Trav.&L.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0D8Q23	iShares ATX UCITS ETF DE ¹⁾	0,30
DE0005933931	iShares Core DAX UCITS ETF DE Inhaber-Anteile EUR Acc. ¹⁾	0,15
DE000A0H08J9	iShares ST.Eu.600 In.G.&S.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0H08M3	iShares ST.Eu.600 Oil&Gas U.ETF DE ¹⁾	0,46
DE000A0H08N1	ISHARES STiSh.ST.Eu.600 Pe.&H.G.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0H08F7	iShares STOXX.Eur.600 Co.&Mat. ¹⁾	0,45
DE000A0Q4R28	iShares STOXX Europe 600 Automobiles & Parts (DE) ¹⁾	0,46
DE000A0H08E0	iShares STOXX Europe 600 Chemicals (DE) ¹⁾	0,45
IE00B5BMR087	iShares VII-Core S&P 500 U.ETF ¹⁾	0,07
IE00BGR7L912	iShs DL Treas.Bd 0-1yr UC.ETF Registered Shares USD (Dist)oN ¹⁾	0,07
IE00B4L5Y983	iShsIII-Cor.MSCI Wld UCITS ETF Registered Shs Acc. USD o.N. ¹⁾	0,20
IE00B53L4350	iShsVII-DJ Indl Average U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N. ¹⁾	0,33
IE00B53SZB19	iShsVII-NASDAQ 100 UCITS ETF Registered Shares o.N. ¹⁾	0,33
IE00BKWQ0L68	SPDR MSCI Eur.Materials UETF Registered Shares o.N. ¹⁾	0,30
IE00BKWQ0F09	SPDR MSCI Europe Energy UETF Registered Shares o.N. ¹⁾	0,30
IE00B6YX5C33	SPDR S&P 500 UCITS ETF Registered Shares USD o.N. ¹⁾	0,09
IE00BMFKG444	Xtr.IE)Xtr.NASDAQ 100 ETF Reg. Shs 1C USD Acc. oN ¹⁾	0,10
LU0274211480	Xtrackers DAX 1C ¹⁾	0,01
LU0290358497	Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF ¹⁾	0,15

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

BESCHREIBUNG, WIE DIE VERGÜTUNGEN UND GGF. SONSTIGE ZUWENDUNGEN BERECHNET WURDEN

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die Ausgestaltung des Vergütungssystems hat die Gesellschaft in einer internen Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis geregelt. Ziel ist es, ein Vergütungssystem sicherzustellen, das Fehlanreize zur Eingehung übermäßiger Risiken verhindert. Das Vergütungssystem der HANSAINVEST wird unter Einbeziehung des Risikomanagements und der Compliance Beauftragten mindestens jährlich auf seine Angemessenheit und die Einhaltung der rechtlichen Vorgaben überprüft. Eine Erörterung des Vergütungssystems mit dem Aufsichtsrat findet ebenfalls jährlich statt.

Die Vergütung der Mitarbeiter richtet sich grundsätzlich nach dem Manteltarifvertrag für das Versicherungswesen. Je nach Tätigkeit und Verantwortung erfolgt die Vergütung gemäß der entsprechenden Tarifgruppe. Die Ausgestaltung und Vergütungshöhen der Tarifgruppen werden zwischen Arbeitgeber- und Arbeitnehmerverbänden bzw. der Konzernmutter und den Betriebsräten verhandelt, die HANSAINVEST hat hierauf keinen Einfluss. Nur mit wenigen Mitarbeitern inkl. der leitenden Angestellten sind finanzielle Anreizsysteme für variable Vergütungen und Tantiemen vereinbart. Der Anteil der variablen Vergütung darf dabei maximal 30% der Gesamtvergütung ausmachen. Ein Anreiz, ein unverhältnismäßig großes Risiko für die Gesellschaft einzugehen, resultiert aus der variablen Vergütung nicht.

Die Vergütung für die Geschäftsführer der HANSAINVEST erfolgt auf einzelvertraglicher Basis. Sie setzt sich zusammen aus einer monatlichen festen Vergütung und einer jährlichen Tantieme. Die Höhe der Tantieme wird im gesamten Aufsichtsrat erörtert und festgelegt und orientiert sich nicht am Erfolg der einzelnen Fonds.

Derzeit sind nur die Geschäftsführung als Risikoträger der Gesellschaft eingestuft. Die Gesellschaft überprüft die Vergütungssysteme jährlich. Die Vergütungspolitik der HANSAINVEST erfüllt die Anforderungen des § 37 KAGB, als auch die Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der AIFMD (ESMA/2013/232).

ERGEBNISSE DER JÄHRLICHEN ÜBERPRÜFUNG DER VERGÜTUNGSPOLITIK

Im Rahmen der internen jährlichen Überprüfung der Einhaltung der Vergütungspolitik ergaben sich keine Anhaltspunkte dafür, dass die Ausgestaltung von fixen und / oder variablen Vergütungen sich nicht an den Regelungen der Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis orientieren.

ANGABEN ZU WESENTLICHEN ÄNDERUNGEN DER FESTGELEGTEN VERGÜTUNGSPOLITIK

Keine Änderung im Berichtszeitraum

Allgemeine Angaben

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft
mit beschränkter Haftung

Postfach 60 09 45

22209 Hamburg

Hausanschrift:

Kapstadtring 8

22297 Hamburg

Sitz: Hamburg

Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96

Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70

E-Mail: info@hansainvest.de

Web: www.hansainvest.de

Haftendes Eigenkapital: 28,189 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2022

GESELLSCHAFTER

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

AUFSICHTSRAT

- Martin Berger
 - Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)
- Dr. Karl-Josef Bierth (bis zum 07.11.2023)
 - stellvertretender Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Dr. Stefan Lemke (ab dem 15.02.2024)
 - stellvertretender Vorsitzender
 - stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg, Mitglied des Vorstandes der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Markus Barth

- Vorsitzender des Vorstandes der Aramea Asset Management AG, Hamburg

- Dr. Thomas A. Lange

- Vorsitzender des Vorstandes der National-Bank AG, Essen

- Prof. Dr. Harald Stützer

- Geschäftsführender Gesellschafter der STUETZER Real Estate Consulting GmbH, Gerolsbach

- Prof. Dr. Stephan Schüller

- Kaufmann

GESCHÄFTSFÜHRUNG

- Dr. Jörg W. Stotz

- (Sprecher, zugleich Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG und der Greiff capital management AG)

- Claudia Pauls (ab dem 01.04.2024)

- Ludger Wibbeke

- (zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. und Aufsichtsratsvorsitzender der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

VERWAHRSTELLE

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG
Kaiserstr. 24
60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Haftendes Eigenkapital: 575,597 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 28,839 Mio. EUR
Stand: 31.12.2022

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhlentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

info@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST